

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NIX International Money Broking

【2023-02-09】

今日 Fixing 定在 6.7905，较上一交易日上升了 153 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所下降。

短端，O/N 主要成交在-4.3~-4.2。T/N 主要成交在-13.5~-12.6 的位置。S/N 主要成交在-4.4~-4.3 的位置。1w 成交在-34.5，-34.6，-34.8，-35，-35.2，-35.35，-35.5 等位置。2w 成交在-61.8，-62.5 等位置。3w 成交在-94.5 的位置。1s 成交在-125，-125.5，-126，-126.5，-127，-128，-128.5 的位置。2s 成交在-268，-270 等位置。3s 成交在-410，-415，-412，-416，-418，-420 等位置。

中长期，6s 成交在-845，-848，-850，-852 等位置。9s 成交在-1255，-1260，-1265，-1262 等位置。1y 成交在-1610，-1615，-1620，-1621，-1624，-1625，-1630，-1635，-1638，-1645，-1635，-1634，-1636 等位置。

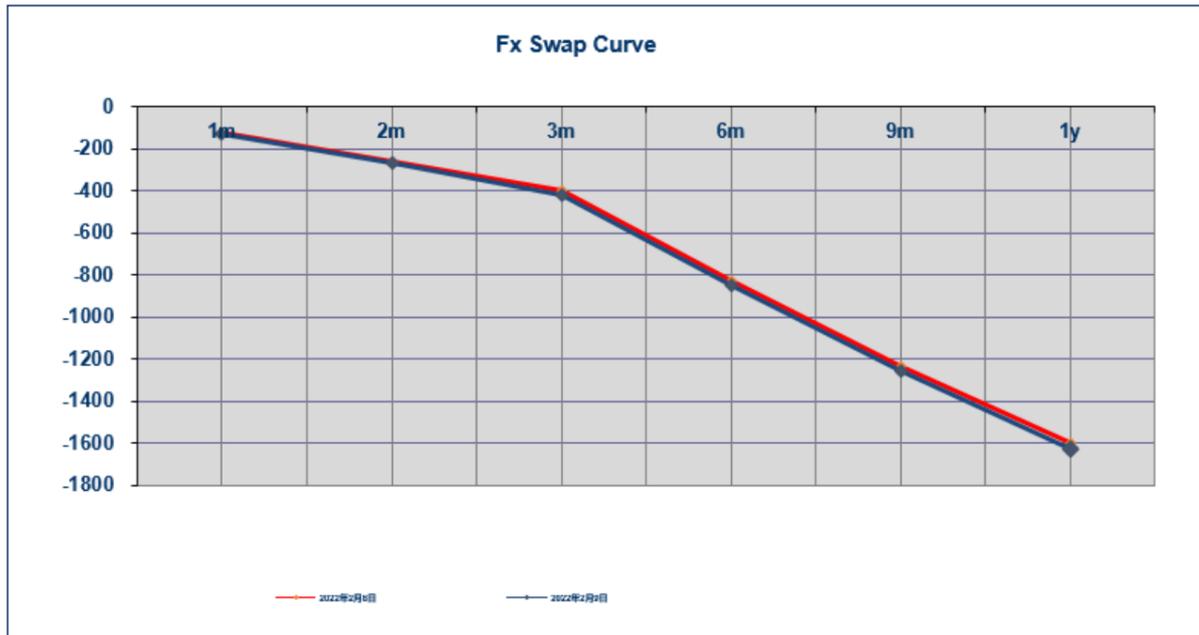
超长期限，2y 成交在-2140 的位置。

Spread 方面，1s*2s 成交在-142 的位置。9s*12s 成交在-370，-372，-373，-375 等位置。6s*12s 成交在-772 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	8	-35	6.7782	-6.72
2W	14	-64	6.7753	-5
1M	28	-128	6.7689	-6
2M	59	-272	6.7545	-11
3M	91	-418	6.7399	-17
6M	182	-853	6.6964	-23
9M	273	-1260	6.6557	-25
1Y	368	-1630	6.6187	-27
18M	547	-2035	6.5782	-85
2Y	731	-2135	6.5682	-85
3Y	1096	-2146	6.5671	-46
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7905	
CLOSING SPOT RATE			6.7817	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-144	-290	-725	-1132	-1502
2M		-146	-581	-988	-1358

3M			-435	-842	-1212
6M				-407	-777
9M					-370



文 / Yiff Wang

联系人: Rafael Wang
 邮箱: rafael.wang@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明:

以上所提及及附加的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司 (以下简称“上海国际货币”) 或第三方, “信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其完整性、时效性或准确性等要求, 且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN